

## DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN.....	iii
PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI .....	iv
DECLARATION .....	v
KATA PENGANTAR .....	vi
ABSTRAK .....	vii
ABSTRACT.....	viii
DAFTAR ISI.....	ix
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR .....	xii
DAFTAR LAMPIRAN.....	xiii
<b>1. PENDAHULUAN .....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Kesenjangan Penelitian.....	6
1.3 Tujuan Penelitian .....	7
1.4 Sistematika Penulisan .....	7
<b>2. TINJAUAN PUSTAKA .....</b>	<b>9</b>
2.1 Landasan Teori .....	9
2.1.1 Teori Nilai Tukar .....	9
2.1.2 Keseimbangan Nilai Tukar .....	9
2.1.3 Keseimbangan Pasar Valuta Asing.....	10
2.1.4 Hubungan Volatilitas Nilai Tukar dan Perdagangan Internasional .....	10
2.1.5 Hubungan Nilai Tukar Terhadap Perdagangan Internasional .....	11
2.2 Penelitian Sebelumnya.....	12
2.3 Hipotesis .....	15
<b>3. METODE PENELITIAN.....</b>	<b>16</b>
3.1 Pendekatan Penelitian .....	16
3.2 Model Empiris .....	16
3.2.1 Model ARIMA .....	16
3.2.2 Model ARCH/GARCH .....	17
3.2.3 Model ECM .....	17
3.3 Definisi Operasional .....	18
3.4 Jenis dan Sumber Data.....	19
3.5 Prosedur Pengumpulan Data.....	19
3.6 Teknik Analisis .....	19
3.6.1 Metode ARCH/GARCH.....	19
3.6.2 Metode ECM .....	22
<b>4. HASIL DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>25</b>
4.1 Gambaran Umum Obyek Penelitian.....	25
4.1.1 Perkembangan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar AS .....	25

4.1.2 Perkembangan Ekspor Komoditas Utama Indonesia Terhadap Amerika Serikat .....	26
4.1.3 Perkembangan Impor Komoditas Utama Indonesia Terhadap Amerika Serikat .....	28
4.1.4 Statistik Deskriptif Variabel .....	31
4.2 Hasil Analisis Model dan Pembuktian Hipotesis .....	31
4.2.1 Hasil Volatilitas Nilai Tukar Dengan Metode ARCH/GARCH...	31
4.2.1.1 Permodelan ARIMA .....	31
4.2.1.2 Permodelan ARCH/GARCH .....	34
4.2.3 Hasil Uji Stasioneritas Seluruh Variabel .....	35
4.2.4 Hasil Uji Kointegrasi Seluruh Model .....	35
4.2.5 Estimasi Model Eskpor Jangka Panjang.....	36
4.2.5 Estimasi Model Impor Jangka Panjang .....	38
4.2.5 Estimasi Model Eskpor Jangka Pendek.....	39
4.2.5 Estimasi Model Impor Jangka Pendek .....	41
4.3 Pembuktian Hipotesis .....	42
4.4 Pembahasan .....	43
4.4.1 Analisis Volatilitas Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar AS .....	43
4.4.2 Pengaruh Volatilitas Nilai Tukar Terhadap Ekspor .....	44
4.4.3 Pengaruh Volatilitas Nilai Tukar Terhadap Impor .....	45
4.4.4 Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Ekspor.....	46
4.4.5 Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Impor .....	47
<b>5. SIMPULAN DAN SARAN .....</b>	<b>49</b>
5.1 Ringkasan Hasil .....	49
5.2 Kesimpulan .....	49
5.3 Saran .....	50
5.4 Keterbatasan Penelitian .....	51
<b>DAFTAR PUSTAKA .....</b>	<b>52</b>